

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	华宝新机遇混合	
场内简称	新机遇 LOF	
基金主代码	162414	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2015 年 6 月 11 日	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	195,006,343.06 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2015 年 7 月 1 日	
下属分级基金的基 金简称	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C
下属分级基金的场 内简称	新机遇 LOF	-
下属分级基金的交 易代码	162414	003144
报告期末下属分级 基金的份额总额	35,312,786.17 份	159,693,556.89 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大

	类资产配置比例。本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷	王小飞
	联系电话	021-38505888	021-60637103
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588、400-820-5050	021-60637228
传真		021-38505777	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄孔威	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人	北京市西城区太平桥大街 17 号、中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C
本期已实现收益	-109,265.90	-693,024.72

本期利润	2,061,675.76	8,657,473.82
加权平均基金份额本期利润	0.0550	0.0539
本期加权平均净值利润率	3.39%	3.35%
本期基金份额净值增长率	3.36%	3.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	21,175,180.09	93,993,283.57
期末可供分配基金份额利润	0.5996	0.5886
期末基金资产净值	57,725,476.47	259,262,385.03
期末基金份额净值	1.6347	1.6235
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	63.47%	53.44%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝新机遇混合

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.70%	0.21%	0.37%	0.01%	0.33%	0.20%
过去三个月	0.80%	0.22%	1.12%	0.01%	-0.32%	0.21%
过去六个月	3.36%	0.22%	2.23%	0.02%	1.13%	0.20%
过去一年	-0.18%	0.22%	4.50%	0.01%	-4.68%	0.21%
过去三年	17.42%	0.22%	13.49%	0.01%	3.93%	0.21%
自基金合同生效起 至今	63.47%	0.29%	36.40%	0.01%	27.07%	0.28%

## 华宝新机遇混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.69%	0.21%	0.37%	0.01%	0.32%	0.20%
过去三个月	0.77%	0.22%	1.12%	0.01%	-0.35%	0.21%
过去六个月	3.31%	0.22%	2.23%	0.02%	1.08%	0.20%
过去一年	-0.28%	0.22%	4.50%	0.01%	-4.78%	0.21%
过去三年	17.08%	0.22%	13.49%	0.01%	3.59%	0.21%
自基金合同生效起 至今	53.44%	0.31%	31.08%	0.01%	22.36%	0.30%

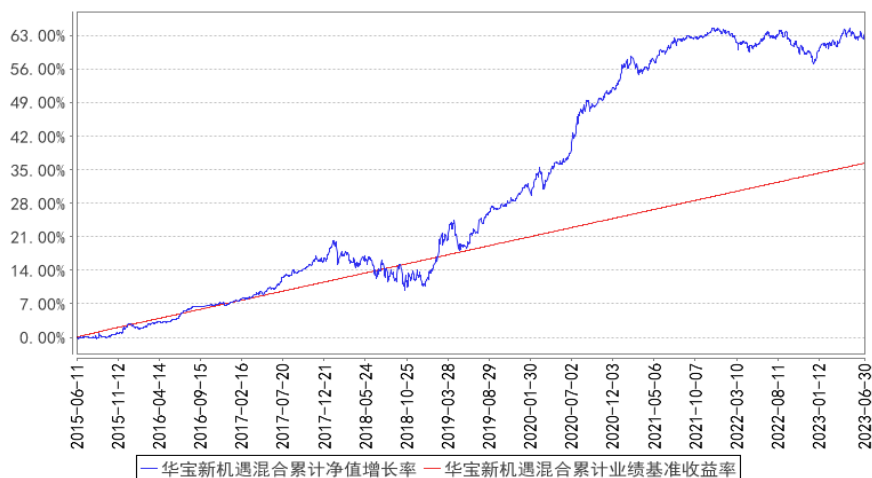
注：（1）基金业绩基准：1 年期银行定期存款基准利率（税后）+3%；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

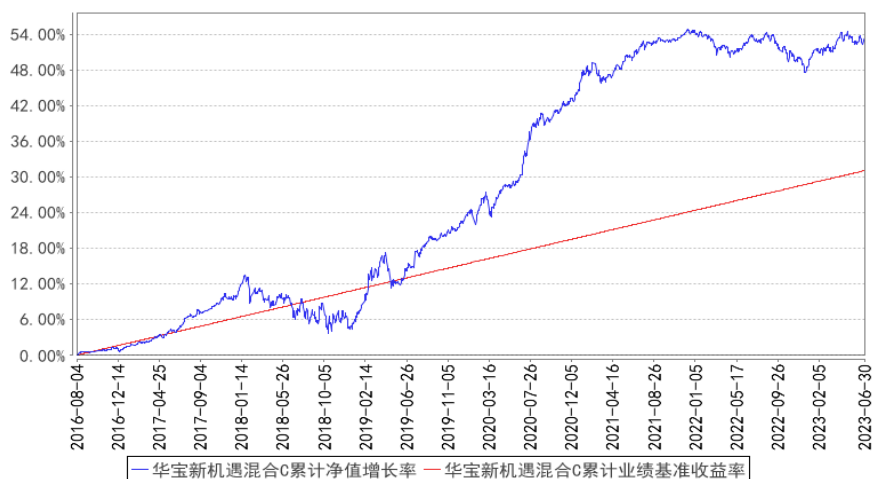


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝新机遇混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝新机遇混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2015 年 12 月 11 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别

为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。截至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 139 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林昊	本基金基金经理	2017-03-17	-	17 年	硕士。2006 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任渠道经理、交易员、高级交易员、基金经理助理等职务。2017 年 3 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 3 月至 2023 年 3 月任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 12 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 12 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 8 月至 2021 年 3 月任华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 11 月起任华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝宝利纯债 86 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020 年 9 月起任华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 3 月任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金基金经理	2023-04-20	-	8 年	硕士。2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 8 月起任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理，2023 年 4 月起任华宝新机

					遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理, 2023 年 4 月起任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
唐雪倩	本基金的基金经理助理	2018-01-23	2023-04-21	8 年	2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司, 先后担任分析师、基金经理助理等职务。2018 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 2018 年 1 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理, 2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 2019 年 2 月至 2022 年 8 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理, 2021 年 8 月至 2021 年 10 月任华宝安享混合型证券投资基金基金经理助理, 2021 年 9 月至 2021 年 10 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理助理, 2018 年 1 月至 2023 年 4 月任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理助理, 2018 年 1 月起任华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理, 2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 8 月起任华宝高端装备股票型发起式证券投资基金基金经理, 2023 年 4 月起任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理, 2023 年 4 月起任华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内, 本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年债券市场收益率先上后下，整体较去年末有所下行。金融数据方面，在一季度信贷大幅放量后，二季度商业银行整体投放节奏有所放缓，1-6 月新增人民币信贷合计 15.73 万亿元，1-6 月新增社融合计 21.55 万亿元，均处于近年来高位。经济数据方面，1-6 月，全国固定资产投资同比增长 3.8%，其中房地产、制造业和基建（不含电力）投资的累计同比增速分别为 -7.9%、6.0%和 7.2%，地产延续回落趋势，基建和制造业投资维持韧性。上半年社会消费品零售总额同比 8.2%，消费潜力逐步释放，线下消费场景加快恢复，接触性聚集性消费持续回暖，服务消费强劲复苏。出口受高基数和海外需求走弱影响，同比数据进一步回落，6 月按美元计出口同比增速从 5 月的 -7.5% 降至 -12.4%，但贸易顺差从 5 月的 658 亿美元增加至 706 亿美元。通胀呈现环比回落的态势，6 月 CPI 同比持平，环比增长 -0.2%，主要受到猪肉价格的负向拉动；PPI 同比

下降 5.4%，环比增长-0.8%，主要受到生产资料拖累，生产和投资端的需求仍待回升。货币政策维持宽松，中国人民银行在 6 月 13 日的公开市场操作中，下调了 7 天逆回购 10BP 至 1.90%，随后在 6 月 15 日超额续作 MLF 中相应调低利率至 2.65%，银行间流动性充裕，二季度跨季资金面波动相较于一季度末更趋缓和。整体来看，无风险收益率曲线呈现向下平移态势，1 年国债、国开较去年末分别下行 22BP、14BP 至 1.87%、2.09%；10 年国债、国开较去年末分别下行 20BP、22BP 至 2.64%和 2.77%。

权益方面，市场表现随宏观经济预期的变动而有所波动，其中一季度经济自去年四季度低点边际改善，基建、消费、出行等行业的景气度恢复，叠加流动性的宽裕和新技术的出现，市场指数总体上行。但经济复苏路径在二季度有所波动，总体需求在一季度集中释放后动能偏弱，市场表现重归波动，且行业分化再次扩大。整体而言，上半年沪深 300、中证 500、中证 1000 指数分别涨跌-0.75%、2.29%、5.10%，国证成长、国证价值分别变动-6.21%、4.77%，流动性宽松的环境下小盘股阶段性强于大盘，除 TMT 行业一枝独秀以外，弱复苏格局下价值风格整体强于成长。基金上半年继续明确组合收益特征目标，保持风险收益的审慎平衡，在弱势市场环境下强化对价值风格的保持，在指数下修和估值消化的过程中对未来权益市场表现渐进乐观，组合构建中重视资产的经营质地、稳定性能力和估值性价比，力争通过有性价比的超额收益提高基金的风险收益回报。

新机遇混合型基金在二季度调整了债券投资比例和组合久期，增加了中长端利率债的配置，以获取无风险利率下行的收益。本基金将继续保持大类资产的平衡配置，并且积极参与新股网下申购来提高收益，本基金始终坚持绝对收益的投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 类净值增长率为 3.36%，本报告期基金份额 C 类净值增长率为 3.31%；同期业绩比较基准收益率为 2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，重要会议的定调提振了市场信心。地方政府专项债的加速发行和使用，地产政策的适时适度调整，以及化解地方债务风险的一揽子方案均有利于拉动投资端企稳回升；积极扩大国内需求，增加居民收入、提高消费能力，有望进一步加强消费在宏观经济运行中稳定器的作用；多举措稳住外贸、外资基本盘，增加国际航班、保障中欧班列稳定畅通，有利于改善与外部经济体的沟通与协作，保持出口增长稳定。国内货币政策大概率继续维持宽松的局面，海外央行的加息进程也将进入尾声。债券市场在宽信用初期，无风险利率仍有一定下行空间，从收益率曲线看，短端的受益性更加确定，长端将在一个较宽的区间内震荡。权益市场方面，尽管上半年权

益资产在指数层面表现相对波动，但相对偏弱的短期市场走势也内化了较为充分的风险预期，实际数据显示 6 月经济数据较 5 月的下行速度减缓，叠加降息政策的出台和更多政策的预期，投资者预期将有望持续修正。对于相对偏质优的资产，目前沪深 300 指数的 PE 及风险溢价率均处于历史最优的 25%左右分位数，指数层面进一步大幅度下行的空间有限，预期的消化、经济的当前状态和组合的估值水平是一个动态演化的过程，我们对未来权益部分的表现保持相对乐观。随着预期的触底和政策的逐步推出，基金在上半年债强股弱的环境下完成了预期的收益目标，未来将继续保持对市场的理解和跟踪，做好整体组合管理。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,770,347.04	3,664,746.01
结算备付金		25,474,242.33	23,804,050.66
存出保证金		2,350,413.15	2,542,468.61
交易性金融资产	6.4.7.2	266,726,088.46	289,552,127.51
其中：股票投资		102,508,535.73	109,222,492.44
基金投资		-	-
债券投资		164,217,552.73	180,329,635.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	20,516,244.60	20,007,717.80
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	79,813.36
应收股利		-	-
应收申购款		2,459.33	853.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		317,839,794.91	339,651,777.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		414,714.19	-
应付赎回款		32,534.22	19,471.59
应付管理人报酬		154,370.75	176,767.95
应付托管费		64,321.15	73,653.31
应付销售服务费		20,965.33	23,992.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,918.34	18,826.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	152,109.43	452,928.35
负债合计		851,933.41	765,640.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	195,006,343.06	215,392,785.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	121,981,518.44	123,493,351.50
净资产合计		316,987,861.50	338,886,137.11
负债和净资产总计		317,839,794.91	339,651,777.70

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 195,006,343.06 份，其中华宝新机遇混合基金份额总额 35,312,786.17 份，基金份额净值 1.6347 元；华宝新机遇混合 C 基金份额总额 159,693,556.89 份，基金份额净值 1.6235 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日



单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		12,309,441.94	-3,647,163.57
1. 利息收入		288,639.05	482,447.15
其中：存款利息收入	6.4.7.13	215,066.04	299,283.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		73,573.01	183,163.90
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		494,685.24	3,948,995.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,578,146.13	-10,606,343.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,808,907.78	9,465,823.78
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-158,383.63	3,771,002.10
股利收益	6.4.7.19	1,422,307.22	1,318,512.65
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	11,521,440.20	-8,148,949.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	4,677.45	70,343.46
<b>减：二、营业总支出</b>		1,590,292.36	3,682,245.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	953,054.71	2,313,616.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	397,106.09	964,007.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	128,685.96	281,047.82
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		7,404.67	16,611.14

8. 其他费用	6.4.7.23	104,040.93	106,962.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,719,149.58	-7,329,409.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,719,149.58	-7,329,409.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,719,149.58	-7,329,409.35

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	215,392,785.61	-	123,493,351.50	338,886,137.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	215,392,785.61	-	123,493,351.50	338,886,137.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,386,442.55	-	-1,511,833.06	-21,898,275.61
（一）、综合收益总额	-	-	10,719,149.58	10,719,149.58
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-20,386,442.55	-	-12,230,982.64	-32,617,425.19
其中：1. 基金申购款	3,612,283.48	-	2,252,044.21	5,864,327.69
2. 基金赎回款	-23,998,726.03	-	-14,483,026.85	-38,481,752.88
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	195,006,343.06	-	121,981,518.44	316,987,861.50
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	551,017,751.35	-	352,246,671.50	903,264,422.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	551,017,751.35	-	352,246,671.50	903,264,422.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-169,428,629.3 2	-	-111,419,332.2 1	-280,847,961.53
（一）、综合收益总额	-	-	-7,329,409.35	-7,329,409.35
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-169,428,629.3 2	-	-104,089,922.8 6	-273,518,552.18
其中：1. 基金申购款	25,938,501.91	-	16,343,937.43	42,282,439.34
2. 基金赎回款	-195,367,131.2 3	-	-120,433,860.2 9	-315,800,991.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产(基金净值)	381,589,122.03	-	240,827,339.29	622,416,461.32
-----------------	----------------	---	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>向辉</u>	<u>向辉</u>	<u>张幸骏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原名为华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF),以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 801 号《关于准予华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,437,765,787.61 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 60737318\_B27 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2015 年 6 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,438,056,502.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 290,715.32 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《关于华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》及更新后的《华宝兴业新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》,自 2016 年 8 月 4 日起,本基金增设 C 类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回 A 类基金份额;可通过场外渠道申购与赎回 C 类基金份额。A 类基金份额参与上市交易,C 类基金份额不参与上市交易。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业新机遇灵活配置混合

型证券投资基金(LOF)于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益品种和货币市场工具(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、大额存单等)、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的比例为基金资产的 0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:1 年期银行定期存款基准利率(税后)+3%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,770,347.04
等于：本金	2,769,585.44
加：应计利息	761.60
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,770,347.04

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	101,468,241.22	-	102,508,535.73	1,040,294.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市	-	-	-
	银行间市	160,840,117.40	2,661,552.73	164,217,552.73

	场				
	合计	160,840,117.40	2,661,552.73	164,217,552.73	715,882.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		262,308,358.62	2,661,552.73	266,726,088.46	1,756,177.11

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-19,844,498.59	-	-	-
其中：股指期货投资	-19,844,498.59	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-19,844,498.59	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2307	IF2307	-13.00	-14,938,560.00	111,818.59
IF2309	IF2309	-4.00	-4,606,800.00	187,320.00
合计				299,138.59
减：可抵销期货暂收款				299,138.59
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。



## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,516,244.60	-
银行间市场	-	-
合计	20,516,244.60	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	67,802.48
其中：交易所市场	66,952.48
银行间市场	850.00
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	152,109.43

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝新机遇混合

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,143,898.25	40,143,898.25
本期申购	531,758.56	531,758.56
本期赎回（以“-”号填列）	-5,362,870.64	-5,362,870.64
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	35,312,786.17	35,312,786.17

## 华宝新机遇混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	175,248,887.36	175,248,887.36
本期申购	3,080,524.92	3,080,524.92
本期赎回 (以“-”号填列)	-18,635,855.39	-18,635,855.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	159,693,556.89	159,693,556.89

## 6.4.7.8 其他综合收益

## 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

## 华宝新机遇混合

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,215,043.99	-870,789.77	23,344,254.22
本期利润	-109,265.90	2,170,941.66	2,061,675.76
本期基金份额交易产生的变动数	-2,930,598.00	-62,641.68	-2,993,239.68
其中：基金申购款	323,422.74	9,146.39	332,569.13
基金赎回款	-3,254,020.74	-71,788.07	-3,325,808.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,175,180.09	1,237,510.21	22,412,690.30

## 华宝新机遇混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,908,388.38	-3,759,291.10	100,149,097.28
本期利润	-693,024.72	9,350,498.54	8,657,473.82
本期基金份额交易产生的变动数	-9,222,080.09	-15,662.87	-9,237,742.96
其中：基金申购款	1,835,889.06	83,586.02	1,919,475.08
基金赎回款	-11,057,969.15	-99,248.89	-11,157,218.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,993,283.57	5,575,544.57	99,568,828.14

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	8,555.35
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	

结算备付金利息收入	206,428.27
其他	82.42
合计	215,066.04

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	25,689,817.89
减：卖出股票成本总额	28,203,826.88
减：交易费用	64,137.14
买卖股票差价收入	-2,578,146.13

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,634,405.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-825,498.10
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,808,907.78

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	92,626,814.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	91,609,878.37
减：应计利息总额	1,840,883.84
减：交易费用	1,550.00
买卖债券差价收入	-825,498.10

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-158,383.63

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,422,307.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,422,307.22

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,135,971.59
股票投资	6,536,613.22
债券投资	4,599,358.37
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	385,468.61
权证投资	-
期货投资	385,468.61
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	11,521,440.20

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,677.45
合计	4,677.45

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,138.37
账户维护费	18,000.00
上清所 CFCA 证书服务费	600.00
合计	104,040.93

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人, 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人, 基金销售机构
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华宝证券	7,000,000.00	1.33	-	-

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	953,054.71	2,313,616.86
其中：支付销售机构的客户维护费	107,519.36	201,976.20

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	397,106.09	964,007.04

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C	合计

华宝基金	-	105,392.73	105,392.73
合计	-	105,392.73	105,392.73
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C	合计
华宝基金	-	221,352.26	221,352.26
合计	-	221,352.26	221,352.26

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C
基金合同生效日(2015 年 6 月 11 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,203,355.95	7,273,785.27
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00

报告期末持有的基金份额	2, 203, 355. 95	7, 273, 785. 27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6. 24%	4. 55%
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C
基金合同生效日( 2015 年 6 月 11 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2, 203, 355. 95	7, 273, 785. 27
报告期内申购/买入总份额	0. 00	0. 00
报告期内因拆分变动份额	0. 00	0. 00
减: 报告期内赎回/卖出总份额	0. 00	0. 00
报告期末持有的基金份额	2, 203, 355. 95	7, 273, 785. 27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1. 81%	2. 80%

注: 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6. 4. 10. 5. 2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

#### 6. 4. 10. 6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2, 770, 347. 04	8, 555. 35	7, 001, 119. 11	26, 050. 43

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 6. 4. 10. 7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6. 4. 11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。



## 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	6.58	7.58	1,015	6,678.70	7,693.70	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	355	3,677.80	4,203.20	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	310	3,614.60	3,800.60	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	108	2,805.84	2,649.24	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	17.80	17.89	335	5,963.00	5,993.15	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	36.15	38.13	295	10,664.25	11,248.35	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	679	9,614.64	11,006.59	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	933	11,289.30	11,261.31	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	309	7,292.40	19,983.03	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.20	25.53	340	6,528.00	8,680.20	-
688433	华曙高	2023 年	6 个月	新股锁	26.66	31.50	254	6,771.64	8,001.00	-

	科	4月7日		定							
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	555	21,023.40	16,366.95		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	3,478	19,789.82	18,815.98		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	1,218	13,519.80	20,754.72		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	366	11,902.32	15,507.42		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	205	6,967.95	6,045.45		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	303	12,116.97	11,123.13		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	245.56	122.11	49	12,032.44	5,983.39		-
688507	索辰科技	2023年6月20日	3个月	新股锁定-送股	-	122.11	23	-	2,808.53		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	426	8,911.92	8,162.16		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	437	9,552.82	10,422.45		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	99	15,085.62	13,461.03		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	226	9,869.42	11,989.30		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	424	8,976.08	9,964.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	569	7,214.92	12,694.39		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	339	10,258.14	8,586.87		-

688581	安杰思	2023年 5月12 日	6个月	新股锁 定	125.80	118.03	75	9,435.00	8,852.25	-
688582	芯动联 科	2023年 6月21 日	6个月	新股锁 定	26.74	40.68	348	9,305.52	14,156.64	-
688593	新相微	2023年 5月25 日	6个月	新股锁 定	11.18	14.59	711	7,948.98	10,373.49	-
688603	天承科 技	2023年 6月30 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科 技	2023年 6月30 日	6个月	新股锁 定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年 6月15 日	6个月	新股锁 定	10.68	12.34	950	10,146.00	11,723.00	-
688623	双元科 技	2023年 5月31 日	6个月	新股锁 定	125.88	86.79	83	10,448.04	7,203.57	-
688629	华丰科 技	2023年 6月16 日	6个月	新股锁 定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信 息	2023年 6月19 日	6个月	新股锁 定	25.28	29.87	248	6,269.44	7,407.76	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型的证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票和债券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、

控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于大型股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,244,410.96	40,728,083.28
合计	20,244,410.96	40,728,083.28

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	20,810,988.49	40,478,872.33
AAA 以下	-	20,189,123.29
未评级	123,162,153.28	78,933,556.17
合计	143,973,141.77	139,601,551.79

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结

算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,770,347.04	-	-	-	2,770,347.04
结算备付金	25,474,242.33	-	-	-	25,474,242.33
存出保证金	4,969.95	-	-	2,345,443.20	2,350,413.15
交易性金融资产	20,244,410.96	102,712,688.22	41,260,453.55	102,508,535.73	266,726,088.46
买入返售金融资产	20,516,244.60	-	-	-	20,516,244.60
应收申购款	-	-	-	2,459.33	2,459.33
资产总计	69,010,214.88	102,712,688.22	41,260,453.55	104,856,438.26	317,839,794.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,534.22	32,534.22
应付管理人报酬	-	-	-	154,370.75	154,370.75
应付托管费	-	-	-	64,321.15	64,321.15
应付清算款	-	-	-	414,714.19	414,714.19
应付销售服务费	-	-	-	20,965.33	20,965.33
应交税费	-	-	-	12,918.34	12,918.34
其他负债	-	-	-	152,109.43	152,109.43
负债总计	-	-	-	851,933.41	851,933.41
利率敏感度缺口	69,010,214.88	102,712,688.22	41,260,453.55	104,004,504.85	316,987,861.50
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,664,746.01	-	-	-	3,664,746.01
结算备付金	23,804,050.66	-	-	-	23,804,050.66
存出保证金	15,823.01	-	-	2,526,645.60	2,542,468.61
交易性金融资产	40,728,083.28	139,601,551.79	-	109,222,492.44	289,552,127.51
买入返售金融资产	20,007,717.80	-	-	-	20,007,717.80
应收申购款	-	-	-	853.75	853.75
应收清算款	-	-	-	79,813.36	79,813.36
资产总计	88,220,420.76	139,601,551.79	-	111,829,805.15	339,651,777.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,471.59	19,471.59
应付管理人报酬	-	-	-	176,767.95	176,767.95
应付托管费	-	-	-	73,653.31	73,653.31
应付销售服务费	-	-	-	23,992.98	23,992.98
应交税费	-	-	-	18,826.41	18,826.41
其他负债	-	-	-	452,928.35	452,928.35
负债总计	-	-	-	765,640.59	765,640.59
利率敏感度缺口	88,220,420.76	139,601,551.79	-	111,064,164.56	338,886,137.11



注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	2,529,632.93	1,290,700.54
2. 市场利率上升 25 个基点	-2,400,330.62	-1,281,559.27	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下和自下而上相结合”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及投资组合构建的策略；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	102,508,535.73	32.34	109,222,492.44	32.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	102,508,535.73	32.34	109,222,492.44	32.23

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	13,298,489.05	-11,108,274.25
	2. 业绩比较基准下降 5%	-13,298,489.05	11,108,274.25

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	102,079,354.76	108,634,450.11
第二层次	164,294,057.73	180,329,635.07
第三层次	352,675.97	588,042.33
合计	266,726,088.46	289,552,127.51

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	102,508,535.73	32.25
	其中：股票	102,508,535.73	32.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	164,217,552.73	51.67
	其中：债券	164,217,552.73	51.67
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,516,244.60	6.45
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	28,244,589.37	8.89
8	其他各项资产	2,352,872.48	0.74
9	合计	317,839,794.91	100.00

注：本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,286,945.00	0.41
B	采矿业	8,040,887.60	2.54
C	制造业	55,197,003.49	17.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,973,754.00	1.25
E	建筑业	2,602,933.03	0.82
F	批发和零售业	1,511,743.70	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	3,605,072.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,070,193.92	0.97
J	金融业	19,378,398.40	6.11
K	房地产业	2,117,177.00	0.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	674,627.59	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,049,800.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	102,508,535.73	32.34

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	4,700	7,947,700.00	2.51
2	300750	宁德时代	14,760	3,376,940.40	1.07
3	601328	交通银行	519,400	3,012,520.00	0.95
4	601988	中国银行	754,300	2,949,313.00	0.93
5	600900	长江电力	109,100	2,406,746.00	0.76
6	600028	中国石化	359,900	2,288,964.00	0.72
7	600919	江苏银行	292,900	2,152,815.00	0.68
8	600938	中国海油	108,855	1,972,452.60	0.62
9	601398	工商银行	408,900	1,970,898.00	0.62
10	601319	中国人保	324,700	1,896,248.00	0.60
11	001965	招商公路	196,100	1,882,560.00	0.59
12	000333	美的集团	30,900	1,820,628.00	0.57
13	000568	泸州老窖	6,800	1,425,076.00	0.45
14	002371	北方华创	4,300	1,365,895.00	0.43
15	601668	中国建筑	237,100	1,360,954.00	0.43
16	000776	广发证券	90,700	1,334,197.00	0.42
17	300316	晶盛机电	18,500	1,311,650.00	0.41
18	300274	阳光电源	11,200	1,306,256.00	0.41
19	002049	紫光国微	13,740	1,281,255.00	0.40
20	002459	晶澳科技	30,156	1,257,505.20	0.40
21	600276	恒瑞医药	25,400	1,216,660.00	0.38
22	601899	紫金矿业	104,900	1,192,713.00	0.38
23	002594	比亚迪	4,500	1,162,215.00	0.37
24	600129	太极集团	19,300	1,148,157.00	0.36
25	601318	中国平安	23,300	1,081,120.00	0.34
26	601098	中南传媒	90,500	1,049,800.00	0.33
27	600933	爱柯迪	44,600	1,038,734.00	0.33
28	601006	大秦铁路	127,000	943,610.00	0.30
29	601288	农业银行	257,100	907,563.00	0.29
30	600888	新疆众和	114,500	906,840.00	0.29
31	000596	古井贡酒	3,600	890,568.00	0.28
32	000063	中兴通讯	19,400	883,476.00	0.28
33	600795	国电电力	225,900	865,197.00	0.27
34	001979	招商蛇口	65,900	858,677.00	0.27
35	002230	科大讯飞	11,900	808,724.00	0.26
36	688036	传音控股	5,500	808,500.00	0.26
37	600958	东方证券	83,000	805,100.00	0.25
38	002920	德赛西威	5,100	794,631.00	0.25
39	600580	卧龙电驱	53,400	780,174.00	0.25
40	600582	天地科技	133,400	777,722.00	0.25
41	603043	广州酒家	27,400	774,324.00	0.24
42	601186	中国铁建	77,600	764,360.00	0.24
43	601211	国泰君安	52,400	733,076.00	0.23

44	600760	中航沈飞	15,960	718,200.00	0.23
45	002531	天顺风能	46,500	708,195.00	0.22
46	300124	汇川技术	10,900	699,889.00	0.22
47	600085	同仁堂	11,900	684,964.00	0.22
48	600325	华发股份	68,900	678,665.00	0.21
49	002516	旷达科技	139,100	673,244.00	0.21
50	000975	银泰黄金	57,200	669,240.00	0.21
51	002821	凯莱英	5,640	664,730.40	0.21
52	600309	万华化学	7,500	658,800.00	0.21
53	002714	牧原股份	15,600	657,540.00	0.21
54	000651	格力电器	18,000	657,180.00	0.21
55	000963	华东医药	14,700	637,539.00	0.20
56	300498	温氏股份	34,300	629,405.00	0.20
57	002129	TCL 中环	18,750	622,500.00	0.20
58	300496	中科创达	6,300	607,005.00	0.19
59	000683	远兴能源	81,100	583,109.00	0.18
60	688981	中芯国际	11,500	580,980.00	0.18
61	600048	保利发展	44,500	579,835.00	0.18
62	601857	中国石油	76,600	572,202.00	0.18
63	600971	恒源煤电	71,300	555,427.00	0.18
64	600612	老凤祥	7,900	552,052.00	0.17
65	002410	广联达	16,660	541,283.40	0.17
66	600941	中国移动	5,800	541,140.00	0.17
67	000858	五粮液	3,300	539,781.00	0.17
68	601728	中国电信	95,400	537,102.00	0.17
69	002264	新华都	88,600	530,714.00	0.17
70	688120	华海清科	2,086	525,776.30	0.17
71	601628	中国人寿	14,600	510,416.00	0.16
72	300760	迈瑞医疗	1,700	509,660.00	0.16
73	600031	三一重工	30,500	507,215.00	0.16
74	603986	兆易创新	4,700	499,375.00	0.16
75	002837	英维克	16,630	497,902.20	0.16
76	002475	立讯精密	15,200	493,240.00	0.16
77	300122	智飞生物	11,100	490,620.00	0.15
78	600600	青岛啤酒	4,700	487,061.00	0.15
79	601688	华泰证券	34,500	475,065.00	0.15
80	601800	中国交建	43,212	471,442.92	0.15
81	600000	浦发银行	64,300	465,532.00	0.15
82	600295	鄂尔多斯	49,084	440,283.48	0.14
83	000559	万向钱潮	79,300	432,185.00	0.14
84	600436	片仔癀	1,500	429,540.00	0.14
85	300054	鼎龙股份	17,100	422,883.00	0.13
86	601600	中国铝业	75,800	416,142.00	0.13

87	601225	陕西煤业	22,700	412,913.00	0.13
88	600487	亨通光电	28,000	410,480.00	0.13
89	002938	鹏鼎控股	16,600	403,214.00	0.13
90	002460	赣锋锂业	6,520	397,459.20	0.13
91	688390	固德威	2,380	397,126.80	0.13
92	603259	药明康德	6,300	392,553.00	0.12
93	688012	中微公司	2,500	391,125.00	0.12
94	600027	华电国际	58,200	389,358.00	0.12
95	601377	兴业证券	61,800	378,216.00	0.12
96	002384	东山精密	14,200	367,780.00	0.12
97	300196	长海股份	26,200	362,870.00	0.11
98	002179	中航光电	7,982	361,983.70	0.11
99	002709	天赐材料	8,600	354,234.00	0.11
100	601012	隆基绿能	12,268	351,723.56	0.11
101	601966	玲珑轮胎	15,400	342,188.00	0.11
102	600438	通威股份	9,900	339,669.00	0.11
103	000028	国药一致	7,700	335,797.00	0.11
104	000738	航发控制	13,600	331,840.00	0.10
105	600660	福耀玻璃	9,200	329,820.00	0.10
106	601126	四方股份	21,300	323,547.00	0.10
107	601229	上海银行	55,900	321,425.00	0.10
108	600642	申能股份	44,700	312,453.00	0.10
109	600460	士兰微	9,300	281,511.00	0.09
110	002050	三花智控	9,000	272,340.00	0.09
111	300347	泰格医药	4,200	271,068.00	0.09
112	000822	山东海化	39,800	271,038.00	0.09
113	000733	振华科技	2,700	258,795.00	0.08
114	002126	银轮股份	13,800	244,260.00	0.08
115	002831	裕同科技	9,700	236,583.00	0.07
116	688396	华润微	4,500	235,845.00	0.07
117	000983	山西焦煤	24,000	218,400.00	0.07
118	600745	闻泰科技	4,400	215,160.00	0.07
119	002206	海利得	39,500	211,720.00	0.07
120	600030	中信证券	10,480	207,294.40	0.07
121	600377	宁沪高速	20,400	200,532.00	0.06
122	600350	山东高速	30,700	195,559.00	0.06
123	000519	中兵红箭	10,800	195,372.00	0.06
124	601000	唐山港	55,100	194,503.00	0.06
125	601816	京沪高铁	35,800	188,308.00	0.06
126	601995	中金公司	5,000	177,600.00	0.06
127	002601	龙佰集团	9,800	161,700.00	0.05
128	600188	兖矿能源	5,300	158,576.00	0.05
129	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02

130	688472	阿特斯	1,218	20,754.72	0.01
131	688361	中科飞测	309	19,983.03	0.01
132	688469	中芯集成	3,478	18,815.98	0.01
133	688443	智翔金泰	555	16,366.95	0.01
134	688478	晶升股份	366	15,507.42	0.00
135	688582	芯动联科	348	14,156.64	0.00
136	688531	日联科技	99	13,461.03	0.00
137	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
138	688562	航天软件	569	12,694.39	0.00
139	688543	国科军工	226	11,989.30	0.00
140	688620	安凯微	950	11,723.00	0.00
141	688352	颀中科技	933	11,261.31	0.00
142	688146	中船特气	295	11,248.35	0.00
143	688484	南芯科技	303	11,123.13	0.00
144	688334	西高院	679	11,006.59	0.00
145	688523	航天环宇	437	10,422.45	0.00
146	688593	新相微	711	10,373.49	0.00
147	688552	航天南湖	424	9,964.00	0.00
148	688581	安杰思	75	8,852.25	0.00
149	688507	索辰科技	72	8,791.92	0.00
150	688429	时创能源	340	8,680.20	0.00
151	688570	天玛智控	339	8,586.87	0.00
152	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
153	688512	慧智微	426	8,162.16	0.00
154	688433	华曙高科	254	8,001.00	0.00
155	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
156	601061	中信金属	1,015	7,693.70	0.00
157	688631	莱斯信息	248	7,407.76	0.00
158	688623	双元科技	83	7,203.57	0.00
159	688479	友车科技	205	6,045.45	0.00
160	603135	中重科技	335	5,993.15	0.00
161	601065	江盐集团	355	4,203.20	0.00
162	601133	柏诚股份	310	3,800.60	0.00
163	603125	常青科技	108	2,649.24	0.00
164	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
165	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	1,809,167.00	0.53
2	600276	恒瑞医药	1,218,180.00	0.36



3	601899	紫金矿业	1,131,173.00	0.33
4	601288	农业银行	910,134.00	0.27
5	000975	银泰黄金	748,394.78	0.22
6	600309	万华化学	663,532.00	0.20
7	002264	新华都	535,518.00	0.16
8	600000	浦发银行	470,428.00	0.14
9	600436	片仔癀	433,992.00	0.13
10	601995	中金公司	384,275.00	0.11
11	601377	兴业证券	381,306.00	0.11
12	600958	东方证券	380,544.00	0.11
13	601229	上海银行	344,344.00	0.10
14	000028	国药一致	323,393.00	0.10
15	688343	云天励飞	211,914.00	0.06
16	688443	智翔金泰	210,044.60	0.06
17	688469	中芯集成	197,864.06	0.06
18	600377	宁沪高速	193,464.00	0.06
19	600350	山东高速	191,087.00	0.06
20	601000	唐山港	190,095.00	0.06

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000933	神火股份	1,478,825.00	0.44
2	001979	招商蛇口	1,371,170.00	0.40
3	601009	南京银行	1,165,741.00	0.34
4	300059	东方财富	1,135,246.82	0.33
5	601838	成都银行	906,972.00	0.27
6	600048	保利发展	855,334.00	0.25
7	300347	泰格医药	770,606.00	0.23
8	002142	宁波银行	638,976.60	0.19
9	002242	九阳股份	586,264.72	0.17
10	600160	巨化股份	551,030.00	0.16
11	601888	中国中免	524,145.00	0.15
12	002304	洋河股份	522,845.00	0.15
13	688343	云天励飞	501,744.20	0.15
14	002003	伟星股份	500,973.00	0.15
15	601615	明阳智能	469,911.00	0.14
16	688639	华恒生物	407,668.00	0.12
17	600035	楚天高速	404,736.00	0.12
18	601636	旗滨集团	384,560.00	0.11
19	600809	山西汾酒	374,678.00	0.11
20	002932	明德生物	367,403.83	0.11

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,953,256.95
卖出股票收入（成交）总额	25,689,817.89

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	41,260,453.55	13.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,244,410.96	6.39
	其中：政策性金融债	20,244,410.96	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	102,712,688.22	32.40
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	164,217,552.73	51.81

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230009	23 附息国债 09	200,000	20,858,224.04	6.58
2	102281571	22 晋能煤业 MTN015(科创 票据)	200,000	20,857,293.15	6.58
3	102281597	22 成都国投 MTN001	200,000	20,693,019.18	6.53
4	102281632	22 江津园区 MTN002	200,000	20,454,589.59	6.45
5	220024	22 附息国债 24	200,000	20,402,229.51	6.44

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货进行套期保值或仓位调节操作。当进行空头套期保值时，基金持有的卖出股指期货合约价值，不超过基金持有的股票总市值的 20%，基金通过空头套期保值，一定程度上可以规避市场的系统性风险。当进行多头仓位调节时，基金持有的买入股指期货合约价值，不超过基金资产净值的 10%，基金通过持有股指期货多头合约对股票资产进行替代，可以提高投资效率，赚取或有的基差收益和实现更好的头寸管理。截止报告期末，本基金对股指期货的投资符合基金合同的约定，符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,350,413.15
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,459.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,352,872.48

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华宝新机遇混合	4,275	8,260.30	3,531,472.59	10.00	31,781,313.58	90.00
华宝新机遇混合 C	11	14,517,596.08	159,693,556.89	100.00	-	-
合计	4,286	45,498.45	163,225,029.48	83.70	31,781,313.58	16.30

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

华宝新机遇混合

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄海明	111,105.00	21.49
2	于志明	40,002.00	7.74
3	邵建忠	39,526.00	7.65
4	彭博	37,000.00	7.16
5	叶盛楠	29,539.00	5.71
6	陈灵星	24,832.00	4.80
7	李志英	20,000.00	3.87
8	林颖	15,001.00	2.90
9	尹忠岭	14,000.00	2.71
10	李博	13,125.00	2.54

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华宝新机遇混合	232,833.42	0.6593
	华宝新机遇混合 C	0.00	0.0000

	合计	232,833.42	0.1194
--	----	------------	--------

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华宝新机遇混合	0
	华宝新机遇混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华宝新机遇混合	10~50
	华宝新机遇混合 C	0
	合计	10~50

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华宝新机遇混合	华宝新机遇混合 C
基金合同生效日 (2015年6月11日) 基金份额总额	1,438,056,502.93	-
本报告期期初基金份额总额	40,143,898.25	175,248,887.36
本报告期基金总申购份额	531,758.56	3,080,524.92
减：本报告期基金总赎回份额	5,362,870.64	18,635,855.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,312,786.17	159,693,556.89

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

##### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：自 2022 年 12 月 23 日起至本报告期末。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华安证券	1	9,433,195.76	25.89	8,785.09	25.98	-
中金财富	1	7,988,462.04	21.92	7,439.65	22.00	-
兴业证券	2	7,628,443.69	20.94	7,035.36	20.81	-
华泰证券	1	6,130,597.60	16.83	5,709.18	16.88	-
中信证券	2	1,274,479.07	3.50	1,186.85	3.51	-
国泰君安	2	1,147,016.75	3.15	1,068.23	3.16	-
申万宏源	2	504,435.38	1.38	469.76	1.39	-
银河证券	1	476,340.82	1.31	443.62	1.31	-
长江证券	1	330,692.68	0.91	307.97	0.91	-
光大证券	1	324,653.61	0.89	302.36	0.89	-
民生证券	1	276,173.00	0.76	257.18	0.76	-
西部证券	1	225,822.17	0.62	162.89	0.48	-
招商证券	2	147,960.51	0.41	136.29	0.40	-
天风证券	2	126,084.82	0.35	117.42	0.35	-
安信证券	1	120,729.60	0.33	112.44	0.33	-
东亚前海	1	91,831.74	0.25	85.52	0.25	-

证券						
东兴证券	1	86,958.14	0.24	80.13	0.24	-
德邦证券	2	85,622.02	0.23	79.72	0.24	-
国信证券	1	28,206.99	0.08	26.28	0.08	-
方正证券	2	8,071.28	0.02	7.44	0.02	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大和证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	3	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的 地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：财通证券、大和证券、华鑫证券、江海证券、中邮证券；退租交易单元：宏信证券。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华安证券	-	-	14,000,000.00	2.66	-	-
中金财富	-	-	20,031,000.00	3.81	-	-
兴业证券	-	-	15,292,000.00	2.90	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	114,770,000.00	21.80	-	-
国泰君安	-	-	44,079,000.00	8.37	-	-
申万宏源	-	-	29,382,000.00	5.58	-	-
银河证券	-	-	28,844,000.00	5.48	-	-
长江证券	-	-	57,159,000.00	10.86	-	-



光大证 券	-	-	44,577,000.0 0	8.47	-	-
民生证 券	-	-	35,517,000.0 0	6.75	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	25,391,000.0 0	4.82	-	-
安信证 券	-	-	14,000,000.0 0	2.66	-	-
东亚前 海证券	-	-	46,394,000.0 0	8.81	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	4,993,000.00	0.95	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
大和证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券	-	-	-	-	-	-

广发证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国融证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
红塔证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	7,000,000.00	1.33	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华信证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
日信证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	24,986,000.0 0	4.75	-	-
申万宏 源西部	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-

西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金国 际	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券华南	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝基金关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-01-09
2	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司(银银平台)为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-01-13
3	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
4	华宝基金关于旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-02-13
5	华宝基金关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-02-27
6	华宝基金关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-06
7	华宝基金关于华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)新增方正证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报	2023-03-14

8	华宝基金关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-17
9	华宝基金关于旗下部分基金新增申万宏源西部证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-22
10	华宝基金关于旗下部分基金新增申万宏源证券有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-03-22
11	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
12	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-19
13	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	基金管理人网站, 上海证券报	2023-04-20
14	华宝基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
15	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
16	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2023-04-25
17	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	基金管理人网站	2023-04-25
18	华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)	基金管理人网站	2023-04-25
19	华宝基金关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司 (银银平台) 为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-26
20	华宝基金关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-05
21	华宝基金关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-08
22	华宝基金关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-10
23	华宝基金关于旗下部分基金新增中信证券 (山东) 有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-25
24	华宝基金关于旗下部分基金新增中信	基金管理人网站, 上海	2023-05-25

	期货有限公司为代销机构的公告	证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	
25	华宝基金关于旗下部分基金新增中信证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-25
26	华宝基金关于旗下部分基金新增中信证券华南股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-25
27	华宝基金关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-30
28	华宝基金关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-19
29	华宝基金关于旗下部分基金新增上海证券有限责任公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-20
30	华宝基金关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-28
31	华宝基金关于旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-06-29

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101~20230630	81,908,845.44	0.00	0.00	81,908,845.44	42.00

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。

在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下, 如该投资者集中赎回, 可能会增加基金的流动性风险。此外, 由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产, 可能对持有资产的价格形成冲击, 增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产, 加强防范流动性风险、市场风险, 保护持有人利益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同；

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书；

华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日